

# Webcast

## Riesgo de Mercado: Metodologías para el Cálculo del Valor en Riesgo (VaR) Miguel Bello

### Descripción

Taller práctico donde se mostrará las tres metodologías para el cálculo de Valor en Riesgo (VaR), revisando la metodología paramétrica y simulación histórica a partir de MS. Excel y la ventaja que ofrece Risk Simulator para la metodología de simulación de Monte Carlo y el mejoramiento del cálculo paramétrico con la volatilidad dinámica (EWMA).

### Dirigido a

Docentes, Profesionales y estudiantes que se encuentren interesados en la medición de riesgo de mercado con las tres metodologías que se tienen para su cálculo.

### Objetivo

Medir la máxima pérdida esperada para riesgo de mercado de un activo financiero. Mostrar alternativas metodológicas para el cálculo de la volatilidad dinámica EWMA. Calcular el Conditional VaR (CVaR) como alternativa de medición de riesgo de mercado a través de la simulación de Monte Carlo.

### Temario

1. Metodologías para el cálculo de valor en riesgo
  - a. VaR Paramétrico
    - Volatilidad Histórica
    - Volatilidad Dinámica
  - b. VaR Simulación Histórica
  - c. VaR Simulación de Monte Carlo
2. Cálculo del CVaR a partir de la Simulación de Monte Carlo
3. Distribuciones de Valor Extremo (Gumbel Mínima)

### Instructores

#### **Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.**

Economista de la Universidad de la Salle y MBA de la Universidad Villanueva en España. Actualmente, está acreditado con la Certificación Internacional en Gestión de Riesgos-CQRM impartida por el Dr. Johnathan Mun. Consultor y formador especialista en Software Shop. Profesor de estadística, econometría y analítica de datos, a nivel de pregrado y posgrado en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) y otras universidades de Colombia. Cuenta con 7 años de experiencia como conferencista y capacitador internacional en análisis de riesgo y métodos cuantitativos para mejorar la toma de decisiones bajo escenarios de incertidumbre.

# Información General

## Duración

1 Hora

## Fecha de Inicio

Jue. 17 de Nov de 2016

## Horarios

San José de Costa Rica 10:00 a.m

México D.F. 10:00 a.m

Bogotá 11:00 a.m

Quito 11:00 a.m

Lima 11:00 a.m

Caracas 12:00 m

Bolivia 12:00 m

Santiago 1:00 pm

Buenos Aires 1:00 p.m

Herramientas de apoyo



## Políticas

Para conocer en detalle las condiciones y políticas de participación en los eventos, ingrese a nuestro link <https://www.software-shop.com/formacion/politicas>

Inscríbete ahora